

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui besarnya pengaruh kinerja keuangan (*Return On Asset* (ROA), *Net Interest Margin* (NIM), *Non Performing Loan* (NPL), BOPO, dan *Capital Adequacy Ratio* (CAR)) terhadap *return* saham pada perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Data diperoleh dari Laporan Keuangan Tahunan Bank yang diunduh dari www.idx.co.id

periode 2009, 2010, dan 2011. Populasi penelitian ini adalah seluruh bank umum yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2009, 2010, dan 2011. Jumlah sampel sebanyak 25 perusahaan pada tahun 2009, 27 perusahaan pada tahun 2010, dan 29 perusahaan pada tahun 2011 dengan melewati tahap *purposive sampling*. Teknik analisis yang akan dipakai dalam penelitian ini adalah regresi linier berganda untuk memperoleh gambaran yang menyeluruh mengenai hubungan antara variabel satu dengan variabel yang lain.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa variabel *Return On Asset* (ROA), *Net Interest Margin* (NIM), dan *Non Performing Loan* (NPL) tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham. Sedangkan *Capital Adequacy Ratio* (CAR) dan BOPO berpengaruh signifikan terhadap *return* saham.

Hasil penelitian ini diharapkan dapat dijadikan pedoman, baik oleh pihak manajemen perusahaan dalam pengelolaan perusahaan, maupun oleh para investor dalam menentukan strategi investasi.

Kata kunci : *Return On Asset* (ROA), *Net Interest Margin* (NIM), *Non Performing Loan* (NPL), BOPO, *Capital Adequacy Ratio* (CAR), *return* saham